长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金

招募说明书（更新）摘要

（2020 年 3 月 31 日更新）

基金管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇二〇年三月

重要提示

本基金经 2017 年 10 月 26 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1915 号文）准予募集注册，本基金的基金合同已于 2018 年 4 月 26 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人应当全面了解基金的产品特性，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而形成的市场风险、受基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能影响而产生的管理风险、流动性风险、基金的策略风险、特有风险以及其他风险等。

本基金资产可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险和政策风险等。具体风险请查阅招募说明书第十八部分“风险揭示”章节的具体内容。

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和长期平均风险均高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，

但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

招募说明书所载内容截止日为 2020 年 3 月 20 日，有关财务数据和净值表现截至日为 2019 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人交通银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第一部分 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层

法定代表人：周纯

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层

设立日期：2014 年 9 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2014]871 号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2016]30 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：23 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：蒋媛媛

联系电话：4001-166-866

股权结构：长江证券股份有限公司持有公司 100%的股权。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

周纯先生，硕士。现任长江证券股份有限公司副总裁、长江证券（上海）资产管理有限公司董事长。曾任长江证券股份有限公司法律合规部合规管理岗、副总经理，质量控制总部总经理，公司总裁助理。

罗国华先生，学士。现任长江证券股份有限公司副总裁。曾任中国建设银行湖北省分行科员、科长、中国建设银行武汉市新洲区支行副行长，太平人寿上海分公司银行保险部高级经理、湖北分公司副总经理、宁波分公司总经理、银行保险部总经理，长江证券股份有限公司零售客户总部副总经理、总经理、武汉分公司总经理、经纪业务总监、公司总裁助理。

张波先生，硕士。现任长江证券股份有限公司信用业务部副总经理（主持工作）。曾任长江证券股份有限公司武汉彭刘杨路证券营业部交易岗、营运管理总部渠道督导岗\风险管理岗、信用业务部风险管理岗\产品经理岗、信用业务部副总经理，长江证券（上海）资产管理有限公司公司总经理助理、资产管理总部总经理、结构融资部总经理、质量控制部总经理。

黄伟先生，硕士。现任长江证券股份有限公司财务总部总经理。曾任美的集团冰箱事业部总账会计，森萨塔科技有限公司财务主管，长江证券股份有限公司财务分析、财务总部副总经理、财务总部副总经理（主持工作）。

邹伟先生，硕士。现任长江证券股份有限公司风险管理部总经理。曾任长江证券股份有限公司经纪业务总部渠道业务管理岗，风险管理部市场风险管理岗、副总经理。

2、监事

杜琦先生，学士。现任长江证券股份有限公司法律合规部副总经理，长江成长资本投资有限公司合规负责人。

3、公司高级管理人员

周纯先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

唐吟波女士，总经理，中共党员，硕士。曾任泰阳证券有限责任公司（现方正证券）上海延安西路营业部客户部主管，德邦证券股份有限公司经纪业务总部营销部总经理，齐鲁证券有限公司（现中泰证券）经纪业务总部副总经理、上海甘河路营业部总经理，长江证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

范海蓉女士，副总经理，中共党员，硕士。曾任招商证券股份有限公司投资银行部项目经理，上海国际信托有限公司资金信托总部研究员、基金经理助理、资本市场主管、股权信托总部总经理助理、副总经理、总经理。

董来富先生，副总经理、首席风险官，中共党员，硕士。曾任中国建设银行支行信贷负责人、分理处主任、营业部副主任、主任、支行行长，湘财证券股份有限公司合肥长江中路营业部总经理，华融证券股份有限公司信用业务部总经理。

柳祚勇先生，副总经理，中共党员，硕士。曾任长江证券股份有限公司研究员、投资经理助理、投资经理，长江证券（上海）资产管理有限公司总经理助理。

谷松女士，副总经理，中共党员，硕士。曾任长江证券股份有限公司人力资源部业务主管、培训中心副总经理、培训中心总经理、结构金融与场外业务部总经理。

吴迪先生，合规负责人，中共党员，学士。曾任职于湖北省潜江市公安局、公安部证券犯罪侦查局。曾任中泰证券股份有限公司法律事务部副总经理、部门负责人、研究所机构业务部总监，华金证券股份有限公司合规管理部总经理、稽核审计部总经理、风险管理部总经理、首席风险官、合规总监，长江证券股份有

限公司法律合规部总经理。

4、基金经理

曹紫建先生，日本东京大学硕士。现任公司基金管理总部基金经理。曾任职于高盛（东京）投资银行、长江证券股份有限公司。

5、投资决策委员会成员

基金投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理唐吟波女士、基金管理部总经理徐婕女士、基金经理漆志伟先生、基金经理曹紫建先生、风险管理部总经理孙婷女士组成。其中唐吟波女士任基金投资决策委员会主任。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：任德奇

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2019 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，连续五年跻身全球银行 20 强；根据 2019 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 150 位，较上年提升 18 位。

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 99,328.79 亿元。2019 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 601.47 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行托管证券投资基金 436 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、QDIE 资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

第三部分 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

长江证券（上海）资产管理有限公司直销中心：

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

法定代表人：周纯

联系人：蒋媛媛

电话：021-80301221

传真：021-80301399

客户服务电话：4001-166-866

网址：www.cjzcgl.com

2、其他销售机构：

（1）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：李新华

联系人：毕艇

电话：027-65799560

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

（2）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：王菁

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（3）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市北京东路 689 号 25 楼

法定代表人：郑杨

电话：021-61618888

传真：021-63604196

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

（4）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-118-1188

网址：www.66liantai.com

（5）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

机构联系人：李雯

电话：010-65215588

传真：010-85097308

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

（6）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和

经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：骆晥

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

（7）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 04 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 04 室

法定代表人：吕柳霞

联系人：曾芸

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客服电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（8）上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 20 层

法定代表人：林琼

机构联系人：张桂林

电话：021-60907379

传真：021-60907397

客服电话：021-61265457

网址：www.youyufund.com

（9）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

机构联系人：王锋

电话：025-66996699

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

（10）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 19 层 19C13

法定代表人：王伟刚

联系人：宋子琪

电话：400-619-9059

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

（11）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

机构联系人：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn

（12）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（13）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：王敏

电话：（021）20691926

传真：（021）20691861

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（14）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

联系人：郭哲晗

电话：400-821-5399

传真：021-80358749

客服电话：4008-215-399

网址：www.noah-fund.com

（15）喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：王舰正

机构联系人：张萌

电话：010-58349088

传真: 0891-6177483

客服电话：400 699 7719

网址：www.xiquefund.com

（16）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

机构联系人：高源

电话：021-36696312

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（17）长江期货股份有限公司

注册地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层

办公地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层

法定代表人：罗国华

联系人：梅晨

电话：027-85861133

传真：86-27-85860103

客户服务电话：027-85861133 / 95579

网址：www.cjfco.com.cn

（18）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

机构联系人：段颖

联系人传真：54509977-8806

客户服务电话：95021

公司网址：http://fund.eastmoney.com

（19）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

机构联系人：沈晨

电话：010-59336544

传真：010-59336586

客服电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

（20）民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

机构联系人：黄志枫

电话：021-50206003

传真：021-50206001

客服电话：021-50206003

网址：www.msftec.com

（21）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

联系人：王重阳

电话：010-65951887

客服电话： 400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

（22）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源国食苑 10 号

法定代表人：王军辉

机构联系人：王慧超

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

（23）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

公司地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1504/1505 室

法人：张冠宇

联系人：王丽敏

电话：010-85932810

传真：010-85932880

客服电话：400-819-9868

网址：www.tdyhfund.com

（24）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层

法定代表人：周斌

联系人：周斌

电话：010-56623000

传真：010-56623000

客户服务电话：400-8980-618

网址：www.chtfund.com

（25）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

机构联系人：尹文光

客服电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

（26）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

机构联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

（27）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

机构联系人：梁云波

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

客服电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

（28）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路 355 号岗厦皇庭中心 8 楼 E

法定代表人：高锋

机构联系人：付燚杰

电话：0755-82880158

传真：0755-83655518

客服电话：400-804-8688

网址：www.keynesasset.com

（29）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区

法定代表人：冯轶明

机构联系人：范泽杰

电话：021-20530186

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

（30）深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1

办公地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1

法定代表人：苗宏升

机构联系人：廖嘉琦

电话：0755-83693789

传真：0755-83697373

客服电话：400-790-3688

网址：www.fundying.com

（31）中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人：弭洪军

机构联系人：黄鹏

电话：021-33355333

传真：021-63353736

客服电话：400-876-5716

网址：www.cmiwm.com

（32）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

机构联系人：董一锋

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：952555

网址：www.5ifund. com

（33）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

机构联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

（二）登记机构

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

法定代表人：周纯

联系人：何永生

电话：021-80301382

传真：021-80301399

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、丁媛

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：武汉市武昌区东湖路169号众环大厦

办公地址：武汉市武昌区东湖路169号众环大厦

负责人：石文先

经办注册会计师：刘钧、余宝玉

联系电话：027-85424319

传真：027-85424329

联系人：刘钧

第四部分 基金的名称

长江汇聚量化多因子混合型发起式证券投资基金

第五部分 基金的类型

混合型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

本基金通过数量化投资模型，合理配置资产权重，精选行业与个股，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

（一）投资策略

本基金充分发挥公司资源优势、构建高质量的基础数据库，自上而下的资产

配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化各类资产的比例以确保风险收益最大化。在股票投资过程中，本基金将坚持量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

1、资产配置策略

本基金采用“自上而下”的资产配置方法，通过对宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、 投资者行为等因素分析预测各大类资产的趋势，并利用资产配置模型确定本基金资产在股票、债券及其他金融工具等类别资产间的分配比例。

2、股票投资策略

本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的数量化选股策略，并根据市场变化趋势如热门主题、事件驱动策略，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，从而取得稳健的收益。

（1）行业配置

本基金采用结合行业多因子模型和资产配置模型的量化策略进行行业配置。投资策略中对每一个行业都分别建立高质量的特属因子库，以行业指数为行业代表，并针对行业指数建立行业多因子模型，获得各行业指数的预期收益率，并结合行业指数历史收益率和波动率等指标，对行业配置权重进行优化。

（2）个股选择

本基金在确定行业权重配置后，针对每个行业内运用多因子模型进行个股的选择，个股因子库包括技术因子、质量因子、估值因子、盈利因子、杠杆因子等，利用线性或者非线性等数学统计方法挑选出最终的目标股票池。我们基于经典的 Barra 模型配置期初的因子池，结合因子本身的生命周期进行逐步回归得到最佳的目标因子组合。另外，本基金还会根据市场趋势，基于事件驱动的大数据因子选股，通过爬虫等数据收集手段找寻到有事件预告的公司，如分红派息、高管增持、业绩预增、定增破发等，并通过智能替换策略代替同行业内表现不好的个股。当股票投资组合构建完成后，基金管理人会进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期优化个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。

3、债券投资策略

在大类资产配置基础上，本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整债券资产的平均久期及债券资产配置。本基金具体债券投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、债券回购策略等。

（1）久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。本基金将在对市场利率变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期债券资产组合。

（2）收益率曲线策略

本基金将在确定债券资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

（3）个券选择策略

在对利率产品和信用产品的资产配置上，本基金将综合对宏观周期、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用利差，在风险可控的基础上，动态调整利率产品和信用产品的配置比例。

（4）可转换债券、可交换债券投资策略

本基金将对可转换债券、可交换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪等因素综合考虑可转换债券、可交换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券、可交换债券的投资，创造超额收益。

（5）资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（6）债券回购策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组

合风险管理效果，积极参与债券回购交易，追求债券资产的超额收益。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（二）投资决策依据和投资决策程序

1、投资决策依据

基金投资决策委员会是负责投资决策的最高投资决策机构，负责制定重大投资决策，确定公司所管理资产的长期战略及发展方向。

2、投资决策程序

（1）宏观经济分析师主要从宏观经济分析、货币政策分析和财政政策分析三方面入手，对未来利率变化趋势进行预测；

（2）量化分析师主要从投资对象的收益和风险的匹配关系分析寻找投资机

会，选择最佳的交易策略；

（3）基金经理结合宏观经济、量化策略两方面研究结果定期确定基金投资方案；

（4）基金投资决策委员会审议基金经理的投资方案，形成最终投资方案；

（5）基金经理负责执行通过投资决策委员会审核的投资方案；

（6）交易指令经审核确认无误后，由交易员执行交易指令。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*60%+中国债券综合财富指数收益率*40%

如果法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

第十一部分 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本报告中所列财务数据未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	29,304,843.68	90.80
	其中：股票	29,304,843.68	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,945,854.48	9.13
8	其他资产	24,647.97	0.08
9	合计	32,275,346.13	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	148,477.00	0.47
B	采矿业	736,877.00	2.31
C	制造业	5,588,980.00	17.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	811,075.00	2.54
E	建筑业	2,244,635.00	7.03
F	批发和零售业	264,448.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	403,420.00	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	17,717,069.68	55.49
K	房地产业	1,166,775.00	3.65
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	137,498.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	44,700.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	40,889.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	29,304,843.68	91.78

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通机制，未投资于港股通股票。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	114,400	2,323,464.00	7.28
2	601336	新华保险	43,600	2,142,940.00	6.71
3	601318	中国平安	23,100	1,974,126.00	6.18
4	601818	光大银行	408,000	1,799,280.00	5.64
5	600919	江苏银行	244,200	1,768,008.00	5.54
6	601997	贵阳银行	182,978	1,749,269.68	5.48
7	600016	民生银行	273,100	1,723,261.00	5.40
8	601939	建设银行	237,400	1,716,402.00	5.38
9	601377	兴业证券	145,700	1,031,556.00	3.23
10	600390	五矿资本	97,900	808,654.00	2.53

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支

持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

根据基金合同约定，本基金不得参与国债期货交易。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同约定，本基金不得参与国债期货交易。

（十一）投资组合报告附注

1、本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,695.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,465.33
5	应收申购款	8,487.27
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,647.97

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至 2019 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

（一）长江汇聚量化多因子混合型发起式证券投资基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018年4月26日（基金合同生效日）至	-14.36%	1.11%	-17.32%	0.92%	2.96%	0.19%

2018年12月31日						
2019年1月1日至2019年12月31日	26.34%	1.16%	17.93%	0.88%	8.41%	0.28%
2018年4月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日	8.20%	1.14%	-2.50%	0.90%	10.70%	0.24%

注：本基金的业绩比较基准为中证500指数收益率×60%+中国债券综合财富指数收益率×40%。

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

第十三部分 基金费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券、期货交易费用及结算费用；

（7）基金的银行汇划费用；

（8）基金的相关账户的开户费用、账户维护费用；

（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E× 1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“1、基金费用的种类”中第（3）－（9）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人

指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资运作过程中需要缴纳的增值税，由基金管理人作为纳税人按照税务机关的要求进行核算，从基金财产中支付。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、申购费用

本基金在申购时收取申购费，申购费率随申购金额的增加而递减。本基金申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	1.50%
100 万元≤M＜300 万元	1.00%
300 万元≤M＜500 万元	0.30%
M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔

投资人如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

3、赎回费用

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。本基金赎回费用及计入基金财产的比例按基金份额持有人持有该部分基金

份额的时间分段设定如下：

持有时间（N）	赎回费率	归入基金资产比例
N＜7 天	1.50%	100%
7 天≤N＜30 天	0. 75%	100%
30 天≤N＜3 个月	0.50%	75%
3 个月≤N＜6 个月	0.50%	50%
6 个月≤N＜1 年	0.25%	25%
N≥1 年	0%	25%

（注：3 个月为 90 天，6 个月为 180 天，1 年为 365 天，赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算）

4、基金管理人可以根据相关法律法规或在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并在履行适当程序后，最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以对基金销售费用实行一定的优惠。

6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

第十四部分　对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据和净值表现的截止日期。

2、“第三部分 基金管理人”部分更新了（一）基金管理人概况、（二）主

要人员情况、（七）基金管理人的内部控制制度；

3、“第四部分 基金托管人”部分更新了（一）基金托管人概况、（二）主要人员情况、（三）基金托管业务经营情况、（四）基金托管人的内部控制制度；

4、“第五部分 相关服务机构”部分更新了（一）基金份额发售机构的相关信息；

5、“第十部分 基金投资组合报告”部分更新了本基金投资组合报告，所载数据截止 2019 年 12 月 31 日，报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

6、“第十一部分 基金的业绩”部分更新了本基金的业绩报告，所载数据截止 2019 年 12 月 31 日。

7、“第二十三部分 其它应披露事项”部分更新了本基金 2019 年 4 月 27 日至 2020 年 3 月 20 日应披露的其他事项。

长江证券（上海）资产管理有限公司

二〇二〇年三月三十一日